



【2024-12-23】

今天人民币兑美元中间价报 7.1870，较上一交易日调升 31 个基点。

期权 ATM 方面，1m 成交 4.15/4.2, 6m 成交 5.7625/5.775, 9m 成交 5.85/5.875, 1y 成交 5.9/5.9125。

BF 方面（25d），9m 成交 0.2985/0.3, 1y 成交 0.3。

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
	23/12/2024	7.1870	31
	ATM	Traded	Changes
1w	3.0/5.0		
2w	3.0/5.0		
1s	4.0/6.0	4.15/4.2	
2s	4.0/6.0		
3s	4.0/6.0		
6s	5.0/7.0	5.7625/5.775	
9s	5.0/7.0	5.85/5.875	
1y	5.0/7.0	5.9/5.9125	
2y	5.0/7.0		
3y	4.5/5.5		
	25d RR	Traded	changes
1s	-0.8/0.2		
2s	-0.4/0.0		
3s	0.0/0.4		
6s	0.4/0.7		
9s	0.5/0.7		
1y	0.6/0.8		
	25d FLY	Traded	changes
1w	0.10/0.30		
1s	0.10/0.30		
2s	0.20/0.35		
3s	0.20/0.35		
6s	0.25/0.35		
9s	0.25/0.35	0.2985/0.3	
1y	0.25/0.35	0.3	